华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:华安证券股份有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2021年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年7月1日起至2021年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安证券聚赢一年持有
场内简称	华安证券聚赢一年
基金主代码	970024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年04月26日
报告期末基金份额总额	275,616,644.37份
投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划在严格控制投资风险的前提下，通过定性与定量相结合的方法研究宏观经济和资本市场发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，执行自上而下的资产配置及动态 调整策略、自下而上的个券（股）选择策略，力求实现集合计划资产组合收益长期稳定增长。
业绩比较基准	基准指数＝中证全债指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税 后）×20%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，属于中低等风险/收益的投资品种，其预期风险和预期收益

	水平高于货币市场基金，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。	
基金管理人	华安证券股份有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安证券聚赢一年持有A	华安证券聚赢一年持有B
下属分级基金场内简称	华安证券聚赢一年持有A	华安证券聚赢一年持有B
下属分级基金的交易代码	970024	970025
报告期末下属分级基金的份额总额	143,586,300.38份	132,030,343.99份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	华安证券聚赢一年持有A	华安证券聚赢一年持有B
1.本期已实现收益	3,416,182.20	2,054,185.10
2.本期利润	3,490,345.29	1,800,267.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0231	0.0206
4.期末基金资产净值	150,068,165.86	137,498,398.32
5.期末基金份额净值	1.0451	1.0414

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安证券聚赢一年持有A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个	2.25%	0.07%	1.57%	0.05%	0.68%	0.02%

月						
自基金合同生效起至今	4.51%	0.08%	2.31%	0.05%	2.20%	0.03%

华安证券聚赢一年持有B净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.10%	0.07%	1.57%	0.05%	0.53%	0.02%
自基金合同生效起至今	4.14%	0.08%	2.31%	0.05%	1.83%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券	说明

		任职日期	离任日期	从业年限	
汪志健	基金经理	2020-05-26	-	9年	-
樊艳	基金经理	2020-07-02	-	17年	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华安证券股份有限公司公募资产管理业务公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度超预期降准，资金面偏宽松，市场对货币政策预期不断调整，债券市场整体走强；在债市走强和股市结构性行情的背景下，可转债市场先单边上涨，季末出现一定调整。四季度，工业品涨价向消费端传导、美债利率走向、限电限产、房地产销售额和投资下行、债券供给增加等因素都有可能对市场产生压力，但预计影响有限。报告期内，本基金保持了较低杠杆水平，根据对市场的判断调整资产配置比例和组合久期，小幅降低可转债仓位，增加了利率债和高等级信用债配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华安证券聚赢一年持有A基金份额净值为1.0451元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.25%，同期业绩比较基准收益率为1.57%；截至报告期末华安

证券聚赢一年持有B基金份额净值为1.0414元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.10%，同期业绩比较基准收益率为1.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	236,735,632.29	82.25
	其中：债券	236,735,632.29	82.25
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	39,108,910.50	13.59
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,507,192.40	2.96
8	其他资产	3,488,081.69	1.21
9	合计	287,839,816.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	52,079,473.90	18.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	90,009,836.30	31.30
5	企业短期融资券	70,006,000.00	24.34
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	24,640,322.09	8.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	236,735,632.29	82.32

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	072100120	21平安证券CP008	200,000	20,000,000.00	6.95
2	012103567	21宝钢SCP018	200,000	19,998,000.00	6.95
3	019658	21国债10	170,000	16,962,600.00	5.90
4	188169	21淮投01	150,000	15,171,000.00	5.28
5	019654	21国债06	150,000	15,013,500.00	5.22

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,839.15
2	应收证券清算款	61,199.94
3	应收股利	-
4	应收利息	2,662,942.60
5	应收申购款	747,100.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,488,081.69

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	128037	岩土转债	1,399,752.80	0.49
2	113519	长久转债	1,369,940.00	0.48
3	113033	利群转债	1,244,520.00	0.43
4	110072	广汇转债	1,098,240.00	0.38
5	127019	国城转债	943,760.00	0.33
6	113584	家悦转债	931,681.00	0.32
7	113530	大丰转债	871,840.00	0.30
8	127013	创维转债	827,303.91	0.29
9	128044	岭南转债	792,400.00	0.28

10	113589	天创转债	773,840.00	0.27
11	123077	汉得转债	751,870.00	0.26
12	113017	吉视转债	701,820.00	0.24
13	128132	交建转债	611,460.00	0.21
14	128127	文科转债	542,685.00	0.19
15	127028	英特转债	537,650.00	0.19
16	113591	胜达转债	464,960.00	0.16
17	128116	瑞达转债	463,040.00	0.16
18	128107	交科转债	452,960.00	0.16
19	113588	润达转债	433,640.00	0.15
20	123076	强力转债	416,200.00	0.14
21	113042	上银转债	415,160.00	0.14
22	113534	鼎胜转债	373,080.00	0.13
23	113037	紫银转债	366,800.00	0.13
24	128124	科华转债	362,285.00	0.13
25	128042	凯中转债	360,852.80	0.13
26	127016	鲁泰转债	340,406.45	0.12
27	128130	景兴转债	310,938.80	0.11
28	113542	好客转债	305,470.20	0.11
29	110056	亨通转债	295,579.80	0.10
30	110068	龙净转债	273,075.00	0.09
31	127003	海印转债	269,200.00	0.09
32	113600	新星转债	267,500.00	0.09
33	113599	嘉友转债	263,258.00	0.09
34	127017	万青转债	253,780.00	0.09
35	113578	全筑转债	229,030.40	0.08
36	128145	日丰转债	220,392.00	0.08
37	113525	台华转债	211,160.00	0.07
38	113563	柳药转债	209,740.00	0.07
39	113532	海环转债	209,480.00	0.07
40	128144	利民转债	191,968.70	0.07
41	128105	长集转债	171,900.00	0.06
42	113620	傲农转债	164,551.50	0.06

43	127026	超声转债	163,530.00	0.06
44	128138	侨银转债	163,305.00	0.06
45	113036	宁建转债	160,635.00	0.06
46	123049	维尔转债	153,649.23	0.05
47	123098	一品转债	126,730.00	0.04
48	113516	苏农转债	115,960.00	0.04
49	128117	道恩转债	105,790.00	0.04
50	113044	大秦转债	105,490.00	0.04
51	110064	建工转债	105,410.00	0.04
52	128087	孚日转债	104,280.00	0.04
53	113039	嘉泽转债	86,590.00	0.03
54	113616	韦尔转债	85,482.00	0.03
55	128141	旺能转债	68,230.00	0.02
56	128122	兴森转债	61,625.00	0.02
57	123053	宝通转债	59,770.00	0.02
58	113549	白电转债	59,359.50	0.02
59	123107	温氏转债	56,410.00	0.02
60	113046	金田转债	55,030.00	0.02
61	113619	世运转债	53,775.00	0.02
62	128083	新北转债	52,260.00	0.02

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	华安证券聚赢一年持有A	华安证券聚赢一年持有B
报告期期初基金份额总额	161,519,196.68	55,748,042.36
报告期期间基金总申购份额	-	76,282,301.63
减：报告期期间基金总赎回份额	17,932,896.30	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	143,586,300.38	132,030,343.99

截至报告期末，本公司从业人员及配偶持有华安证券聚赢一年持有A4，498，880.27份，华安证券聚赢一年持有B4，542，299.37份。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会同意合同变更的文件；
2、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；
3、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议；
4、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
5、管理人业务资格批件、营业执照；
6、托管人业务资格批件、营业执照；
7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号。

9.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95318

公司网址：http://www.hazq.com/

华安证券股份有限公司

2021年10月27日